

Απόφαση της Ευρωπαϊκής Αρχής Τραπεζών ΕΒΑ/DC/610

της 27ης Ιανουαρίου 2026

σχετικά με τις ρυθμίσεις για τη λειτουργία επικύρωσης του μοντέλου αρχικού περιθωρίου ασφαλείας σύμφωνα με τον κανονισμό EMIR για το πρότυπο μοντέλο αρχικού περιθωρίου ασφαλείας της Διεθνούς Ένωσης Συμφωνιών Ανταλλαγής και Παραγωγών (ISDA SIMM)

Το συμβούλιο εποπτών

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 1093/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Τραπεζών), την τροποποίηση της απόφασης αριθ. 716/2009/ΕΚ και την κατάργηση της απόφασης 2009/78/ΕΚ της Επιτροπής¹ (ο «κανονισμός ΕΑΤ»), και ιδίως το άρθρο 1 παράγραφος 2, το άρθρο 2, το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχεία β) και ι), το άρθρο 8 παράγραφος 1α στοιχείο α), το άρθρο 8 παράγραφος 2 στοιχείο ι), το άρθρο 31 παράγραφος 2 στοιχεία α), β) και στ) και το άρθρο 35,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 4ης Ιουλίου 2012, για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών² (ο «κανονισμός EMIR»), και ιδίως το άρθρο 11 παράγραφοι 3 και 12α,

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Ο κανονισμός EMIR ορίζει στο άρθρο 11 παράγραφοι 3 και 12α ότι η ΕΑΤ είναι υπεύθυνη για την επικύρωση των τυποποιημένων υποδειγμάτων και κάθε μεταβολής τους. Το πρότυπο μοντέλο αρχικού περιθωρίου ασφαλείας της Διεθνούς Ένωσης Συμφωνιών Ανταλλαγής και Παραγωγών (ISDA SIMM) είναι ένα τέτοιο τυποποιημένο υπόδειγμα. Για την επικύρωση του ISDA SIMM, θα πρέπει να προσδιοριστούν περαιτέρω όλες οι πτυχές της λειτουργίας επικύρωσης που θα εκτελεί η ΕΑΤ σύμφωνα με τον κανονισμό EMIR, ενώ θα πρέπει να θεσπιστεί προσωρινά ένα σύστημα επικύρωσης με την επιφύλαξη του άρθρου 89 παράγραφος 11 του κανονισμού EMIR, έως ότου τεθεί σε λειτουργία η κεντρική βάση δεδομένων της ESMA που προβλέπεται στο άρθρο 17γ του κανονισμού EMIR.
- (2) Δεδομένου του ρόλου της ΕΑΤ ως κεντρικού φορέα επικύρωσης, μεταξύ άλλων μέσω της συνεχούς παρακολούθησης που ασκεί, θα πρέπει να επιδιωχθεί η ευρύτερη δυνατή συμμετοχή στο σύστημα επικύρωσης. Στο πλαίσιο αυτό, η ΕΑΤ, η ΕΙΟΡΑ, η ESMA, οι χρηματοοικονομικοί και μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι που χρησιμοποιούν το ISDA SIMM, οι σχετικές αρμόδιες αρχές και η Διεθνής Ένωση Συμφωνιών Ανταλλαγής και Παραγωγών (ISDA) θα πρέπει να συμμετέχουν ως χρήστες του συστήματος επικύρωσης και να

¹ ΕΕ L331 της 15.12.2010, σ. 12-47.

² ΕΕ L 201 της 27.7.2012, σ. 1.

συνεργάζονται αποτελεσματικά για την ανταλλαγή των απαραίτητων πληροφοριών για το σύνολο των πτυχών της λειτουργίας επικύρωσης.

- (3) Όλες οι πληροφορίες που περιλαμβάνονται στο σύστημα επικύρωσης θα πρέπει να καλύπτονται από το νομικό πλαίσιο της ΕΕ σχετικά με το επαγγελματικό απόρρητο, την εμπιστευτικότητα και την προστασία των δεδομένων προσωπικού χαρακτήρα και η πρόσβαση σε αυτές τις πληροφορίες θα πρέπει να παρέχεται στους χρήστες σύμφωνα με τον κανονισμό της ΕΑΤ. Δεδομένου ότι η ΕΑΤ εξελίσσεται σε σημαντικό κόμβο δεδομένων που έχει ως στόχο τη μείωση του φόρτου και του κόστους υποβολής εκθέσεων και τη βελτίωση της αποτελεσματικότητας για το σύνολο των χρηστών, το σύστημα επικύρωσης θα πρέπει να ενσωματωθεί στην Ευρωπαϊκή Κεντρική Υποδομή Εποπτικών Δεδομένων (EUCLID).
- (4) Για την υποστήριξη της ορθής λειτουργίας του συστήματος επικύρωσης, οι αιτήσεις επικύρωσης θα πρέπει να υπόκεινται σε προηγούμενη διαδικασία ένταξης. Για τον σκοπό αυτό, η ΕΑΤ θα πρέπει να δρομολογήσει μια δομημένη διαδικασία ένταξης με στόχο τη συλλογή όλων των απαραίτητων πληροφοριών για την ταυτοποίηση των αντισυμβαλλομένων με τη χρήση του μοντέλου ISDA SIMM. Οι αρμόδιες αρχές θα πρέπει να παρέχουν στην ΕΑΤ τις επωνυμίες και άλλες σχετικές λεπτομέρειες των χρηματοοικονομικών και μη χρηματοοικονομικών αντισυμβαλλομένων που έχουν υποβάλει αίτηση για άδεια λειτουργίας μοντέλου αρχικού περιθωρίου ασφαλείας με βάση το ISDA SIMM σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 3 τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR. Παράλληλα, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 12α εδάφιο 2 του κανονισμού EMIR, η ISDA θα πρέπει να συνεργάζεται με την ΕΑΤ παρέχοντας πληροφορίες σχετικά με τους αντισυμβαλλομένους που χρησιμοποιούν το ISDA SIMM. Για την αποφυγή επικαλύψεων και τη διασφάλιση της ακρίβειας των δεδομένων, η ΕΑΤ θα πρέπει να συντονίζει τη διαδικασία ένταξης και μπορεί να βασίζεται σε επιβεβαιώσεις από τις αρμόδιες αρχές, κατά περίπτωση.
- (5) Είναι απαραίτητο να διασφαλιστεί ότι οι αρμόδιες αρχές και η ISDA θα παρέχουν άμεσα πληροφορίες σχετικά με τους νέους αντισυμβαλλομένους που χρησιμοποιούν το ISDA SIMM, προκειμένου να διευκολύνεται η διαδικασία ένταξης βάσει της οποίας οι αντισυμβαλλόμενοι θα εκπληρώσουν την υποχρέωσή τους, σύμφωνα με τον κανονισμό EMIR, να υποβάλουν αίτηση για επικύρωση του μοντέλου τους μέσω του συστήματος επικύρωσης.
- (6) Για την εξάλειψη κάθε περιττής επιβάρυνσης και λαμβάνοντας υπόψη ότι η ISDA υποχρεούται βάσει του κανονισμού EMIR να συνεργάζεται αποτελεσματικά με την ΕΑΤ για σκοπούς επικύρωσης, η ISDA θα πρέπει να είναι υπεύθυνη για την έγκαιρη παροχή όλων των αναγκαίων πληροφοριών σχετικά με το μοντέλο και κάθε τυχόν επικαιροποίησή του. Προκειμένου η ΕΑΤ να έχει πλήρη κατανόηση του μοντέλου και της σχεδιαζόμενης επικαιροποίησής του, οι πληροφορίες αυτές θα πρέπει να καλύπτουν τις γενικές πτυχές του μοντέλου που υπόκεινται και εκείνες που δεν υπόκεινται σε επικαιροποίηση.
- (7) Οι εντεταγμένοι χρηματοοικονομικοί και μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι που χρησιμοποιούν το ISDA SIMM θα πρέπει να υποβάλουν αίτηση στην ΕΑΤ για επικύρωση αφού η ΕΑΤ επιβεβαιώσει ότι η ISDA έχει παράσχει πλήρεις πληροφορίες και δικαιολογητικά έγγραφα σχετικά με τα στοιχεία και τις γενικές πτυχές του ISDA SIMM μέσω του συστήματος επικύρωσης ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ. Κατά τον χρόνο υποβολής τους, οι εν λόγω αιτήσεις τεκμαίρεται ότι αναφέρονται και αφορούν το τυποποιημένο υπόδειγμα ISDA SIMM, όπως περιγράφεται από την ISDA ως τον υπεύθυνο ανάπτυξης του μοντέλου στις πληροφορίες και τα δικαιολογητικά έγγραφα που παρέχονται στην ΕΑΤ. Μια τέτοια διαδικασία δύο σταδίων, η οποία περιλαμβάνει, αφενός, την υποβολή από την ISDA

των χαρακτηριστικών του μοντέλου και οποιασδήποτε μεταβολής σε αυτό και, αφετέρου, την υποβολή αίτησης του αντισυμβαλλομένου για επικύρωση του μοντέλου του από την ΕΑΤ, θα πρέπει να ακολουθείται στο πλαίσιο οποιασδήποτε μεταγενέστερης μεταβολής του μοντέλου ISDA SIMM. Προκειμένου να διασφαλίζεται η μέγιστη αποτελεσματικότητα, όταν υποβάλλεται μια αίτηση επικύρωσης μετά την επικύρωση του ισχύοντος SIMM ISDA, η απόφαση επικύρωσης θα πρέπει να λαμβάνεται αυτόματα μέσω του συστήματος.

- (8) Η ISDA θα πρέπει να ενημερώνει την ΕΑΤ για κάθε επικαιροποίηση του ISDA SIMM, αλλά η ΕΑΤ θα πρέπει να διατηρεί την ευελιξία να αξιολογεί ποιες από τις εν λόγω επικαιροποιήσεις συνιστούν μεταβολή μοντέλου για την οποία απαιτείται επικύρωση. Η διαδικασία επικύρωσης του ISDA SIMM θα πρέπει να ενεργοποιείται μόνο για τις επικαιροποιήσεις που η ΕΑΤ κρίνει ότι αποτελούν μεταβολές του μοντέλου.
- (9) Η πρώτη επικύρωση του ISDA SIMM θα πρέπει να περιλαμβάνει όλες τις επικαιροποιήσεις και τις μεταβολές του μοντέλου μέχρι την ημερομηνία έκδοσης της αρχικής απόφασης επικύρωσης. Η προθεσμία έξι ή τριών μηνών που προβλέπεται στον κανονισμό EMIR, εντός της οποίας η ΕΑΤ υπέχει τη νομική υποχρέωση να εγκρίνει ή να απορρίψει την επικύρωση, θα πρέπει επίσης να προσδιορίζεται στην παρούσα απόφαση και να αρχίζει με την πρώτη αίτηση που παραλαμβάνει η ΕΑΤ μέσω του συστήματος επικύρωσης.
- (10) Δεδομένου ότι το ISDA SIMM χρησιμοποιείται ευρέως στην παγκόσμια αγορά και για να αποφευχθεί οποιαδήποτε διαταραχή της αγοράς, η ΕΑΤ θα πρέπει να το επικυρώσει μόλις η ISDA υποβάλει όλες τις απαραίτητες πληροφορίες σχετικά με το μοντέλο και στο μέτρο που η εν λόγω επικύρωση δεν θα θεωρείτο προδήλως ακατάλληλη με βάση τις συνθήκες της αγοράς ή την ανάγκη διασφάλισης της χρηματοπιστωτικής σταθερότητας. Ωστόσο, εάν συντρέχει τέτοια περίπτωση, η αίτηση επικύρωσης του μοντέλου θα πρέπει να απορριφθεί. Για την ενίσχυση της ασφάλειας της αγοράς και την προώθηση της σταθερότητας, η επικύρωση του ISDA SIMM δεν θα πρέπει να υπόκειται σε χρονικό περιορισμό και, ακριβώς για τον λόγο αυτό, θα πρέπει να συνοδεύεται από την επαλήθευση της διαρκούς καταλληλότητας του ISDA SIMM, η οποία θα πρέπει να διασφαλίζεται μέσω της συνεχούς παρακολούθησης του μοντέλου από την ΕΑΤ, όπως προβλέπεται στο άρθρο 11 παράγραφος 12α τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR.
- (11) Η επικύρωση του ISDA SIMM με απόφαση που δεν θα εισάγει χρονικό περιορισμό υπαγορεύει ουσιαστικά ότι η εν λόγω απόφαση μπορεί να ανακληθεί ελεύθερα, εν όλω ή εν μέρει, εφόσον η ΕΑΤ κρίνει, είτε στο πλαίσιο της συνεχούς παρακολούθησης από την ίδια είτε σε ad hoc βάση, μεταξύ άλλων σε καταστάσεις έκτακτης ανάγκης, ότι η διατήρηση της επικύρωσης του ISDA SIMM ενδέχεται να είναι ακατάλληλη με βάση τις συνθήκες της αγοράς ή την ανάγκη διασφάλισης της χρηματοπιστωτικής σταθερότητας. Θα πρέπει να διασφαλίζεται η ανάκληση της επικύρωσης του ISDA SIMM από την ΕΑΤ, όταν η διατήρησή του κρίνεται ακατάλληλη, ανεξάρτητα από το αν οι συστάσεις που διατύπωσε η ΕΑΤ κατά τη διάρκεια της συνεχούς παρακολούθησής της έχουν τηρηθεί από την ISDA ή από οποιονδήποτε άλλο χρήστη του συστήματος επικύρωσης στον οποίο ενδέχεται να απευθύνονται οι εν λόγω συστάσεις. Η άρνηση συνεργασίας εκ μέρους της ISDA θα πρέπει επίσης να οδηγεί σε ανάκληση της επικύρωσης του ISDA SIMM, εκτός εάν και στο μέτρο που αυτό υπαγορεύεται από λόγους χρηματοπιστωτικής σταθερότητας ή ακεραιότητας της αγοράς, καθώς η εν λόγω άρνηση συνεργασίας καθιστά αδύνατη τη συνεχή παρακολούθηση της καταλληλότητας του ISDA SIMM, όπως απαιτείται από τον κανονισμό EMIR.

- (12) Δεδομένου ότι η συνεχής παρακολούθηση συνεισφέρει στοιχεία για την επικύρωση του ISDA SIMM, είναι απαραίτητο να προσδιοριστούν τα στοιχεία που πρέπει τουλάχιστον να περιλαμβάνονται στην παρακολούθηση που διενεργεί η ΕΑΤ. Για να εξασφαλιστεί η διαφάνεια, η ΕΑΤ θα πρέπει να περιλαμβάνει στην ετήσια έκθεσή της που αναφέρεται στον κανονισμό EMIR τα βασικά πορίσματα της εν λόγω παρακολούθησης.
- (13) Οι χρηματοοικονομικοί ή μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι έχουν δικαίωμα ακρόασης μόνον εφόσον η ΕΑΤ προτίθεται να μη χορηγήσει επικύρωση στο ISDA SIMM ή να ανακαλέσει εν μέρει ή πλήρως την επικύρωση.
- (14) Επιβάλλεται να διασφαλιστεί ότι όλοι οι χρήστες του συστήματος επικύρωσης συνεργάζονται αποτελεσματικά και αποδοτικά με την ΕΑΤ, ώστε να μπορεί να εκτελεί τα καθήκοντά της όσον αφορά την επικύρωση. Στο πλαίσιο αυτό, οι αντισυμβαλλόμενοι θα πρέπει να ενημερώνουν την ΕΑΤ εάν έχουν παύσει να συμμορφώνονται προς το ISDA SIMM όπως αυτό ισχύει μετά την πλέον πρόσφατη επικύρωσή του, ενώ οι αρμόδιες αρχές και οι αντισυμβαλλόμενοι θα πρέπει να παρέχουν στην ΕΑΤ όλες τις πληροφορίες που είναι απαραίτητες για τη λειτουργία επικύρωσης σε συνεχή ή σε ad hoc βάση.
- (15) Προκειμένου να διασφαλιστεί η έγκαιρη ανταπόκριση και, παράλληλα, ο σεβασμός προς τις κατοχυρωμένες αρχές που διέπουν τη νόμιμη ανάθεση καθηκόντων, η Μόνιμη Επιτροπή Κανονισμών και Πολιτικής (SCRePoI) θα πρέπει να εξουσιοδοτηθεί να χορηγεί επικυρώσεις μεταγενέστερων μεταβολών, ενώ το συμβούλιο εποπτών θα πρέπει να χορηγεί την αρχική επικύρωση του ISDA SIMM και να αποφασίζει για οιαδήποτε απόρριψη μεταγενέστερης επικύρωσης ή για την ολική ή μερική ανάκληση μιας απόφασης επικύρωσης. Για να ενισχυθεί η ευελιξία, ο εκτελεστικός διευθυντής θα πρέπει να εξουσιοδοτηθεί να λαμβάνει όλες τις τεχνικές αποφάσεις που είναι απαραίτητες για τη λειτουργία του συστήματος επικύρωσης και την εκτέλεση της λειτουργίας επικύρωσης. Το συμβούλιο εποπτών θα πρέπει να ενημερώνεται για όλες αυτές τις μεταγενέστερες επικυρώσεις από τη SCRePoI, καθώς και για τις τεχνικές αποφάσεις του εκτελεστικού διευθυντή, ενώ τίποτα δεν θα πρέπει να εμποδίζει το συμβούλιο εποπτών να ανακαλέσει τις σχετικές εντολές, κατά περίπτωση.
- (16) Για την έκδοση της παρούσας απόφασης, η ΕΑΤ πραγματοποίησε διαβουλεύσεις με την ΕΙΟΠΑ, την ESMA και την ISDA, καθώς και με τις αρμόδιες αρχές που συμμετέχουν στη δομή εσωτερικής διακυβέρνησης της ΕΑΤ.

Εξέδωσε την παρούσα απόφαση:

Άρθρο 1 – Αντικείμενο και πεδίο εφαρμογής

1. Η παρούσα απόφαση θεσπίζει ένα σύστημα πληροφοριών («σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM») ως προσωρινή ρύθμιση έως ότου καταστεί λειτουργική η βάση δεδομένων της ESMA που προβλέπεται στο άρθρο 17γ του κανονισμού EMIR.
2. Η ΕΑΤ, η ESMA, η ΕΙΟΠΑ, οι αρμόδιες αρχές που αναφέρονται στο άρθρο 2 σημείο 13 του κανονισμού EMIR («αρμόδιες αρχές») και οι χρηματοοικονομικοί και μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι που αναφέρονται στο άρθρο 11 του κανονισμού EMIR και χρησιμοποιούν το μοντέλο ISDA SIMM («αντισυμβαλλόμενοι») καθώς και η ISDA είναι οι χρήστες του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM («χρήστες»).

3. Οι πληροφορίες που περιλαμβάνονται στο σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM καλύπτονται από το νομικό πλαίσιο της ΕΕ για το επαγγελματικό απόρρητο, την εμπιστευτικότητα και την προστασία των δεδομένων προσωπικού χαρακτήρα, όπως εφαρμόζεται στην ΕΑΤ. Πρόσβαση σύμφωνα με τα άρθρα 70, 71 και 72 του κανονισμού ΕΑΤ.
4. Οι πληροφορίες που υποβάλλονται στην ΕΑΤ μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM θεωρούνται πληροφορίες που υποβάλλονται μέσω της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Υποδομής Εποπτικών Δεδομένων (EUCLID) και εφαρμόζεται η απόφαση EBA/DC/2020/335 της 5.6.2020 σχετικά με την EUCLID, όπως ισχύει με τις μελλοντικές τροποποιήσεις ή αντικαταστάσεις διατάξεών της.

Άρθρο 2 – Ένταξη αντισυμβαλλομένων

1. Οι αρμόδιες αρχές παρέχουν στην ΕΑΤ, μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, τις πληροφορίες που περιλαμβάνονται στο παράρτημα 1 για όλους τους αντισυμβαλλόμενους που χρησιμοποιούν μοντέλο αρχικού περιθωρίου ασφαλείας βάσει του ISDA SIMM και υποχρεούνται να ζητήσουν την άδεια που αναφέρεται στο άρθρο 11 παράγραφος 3 τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR.
2. Οι αρμόδιες αρχές παρέχουν χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση στην ΕΑΤ τις πληροφορίες που περιλαμβάνονται στο παράρτημα 1 για κάθε αντισυμβαλλόμενο που υποβάλλει αίτηση για τη χορήγηση της εν λόγω άδειας μετά την ημερομηνία εφαρμογής της παρούσας απόφασης.
3. Η ISDA παρέχει στην ΕΑΤ, μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, τις πληροφορίες που περιλαμβάνονται στο παράρτημα 2 για όλους τους νέους αντισυμβαλλόμενους που χρησιμοποιούν το ISDA SIMM και υποχρεούνται να ζητήσουν την άδεια που αναφέρεται στο άρθρο 11 παράγραφος 3 τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR.
4. Μόλις λάβουν την ειδοποίηση από την ΕΑΤ, οι αντισυμβαλλόμενοι πρέπει, χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση, να αποκτήσουν πρόσβαση στο σύστημα επικύρωσης για να ολοκληρώσουν τη διαδικασία ένταξης, μεταξύ άλλων, αναθέτοντας στα αρμόδια πρόσωπα την άσκηση των δικαιωμάτων πρόσβασης στο σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM («εξουσιοδοτημένοι χρήστες») και αποδεχόμενοι τους όρους που αφορούν τη χρήση της γλώσσας.
5. Όσοι αντισυμβαλλόμενοι δεν έχουν λάβει την κοινοποίηση που αναφέρεται ανωτέρω και υποχρεούνται να υποβάλουν αίτηση στην ΕΑΤ για την επικύρωση του μοντέλου τους σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 3 τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR, παραπέμπουν το θέμα στην ΕΑΤ. Μετά από αίτημα της ΕΑΤ, η σχετική αρμόδια αρχή παρέχει αμέσως στην ΕΑΤ τις απαραίτητες πληροφορίες για την ένταξη του εν λόγω αντισυμβαλλομένου.

Άρθρο 3 — Παροχή πληροφοριών και δικαιολογητικών εγγράφων για το ISDA SIMM, καθώς και για κάθε επικαιροποίησή του

1. Η ISDA παρέχει στην ΕΑΤ, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 12α δεύτερο εδάφιο του κανονισμού EMIR, χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση, μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με κάθε άλλο μέσο που κρίνεται κατάλληλο από την ΕΑΤ, κάθε πληροφορία και δικαιολογητικό έγγραφο, συμπεριλαμβανομένων πληροφοριών σχετικά με τα στοιχεία και τις γενικές πτυχές, τη βαθμονόμηση, τον σχεδιασμό και την κάλυψη των μέσων, τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων και τους παράγοντες κινδύνου που σχετίζονται με το ISDA SIMM, καθώς και σχετικά με οποιαδήποτε από τις επικαιροποιήσεις του.
2. Για την πρώτη επικύρωση του ISDA SIMM, η ISDA μεριμνά για την παροχή των πληροφοριών που αναφέρονται στην παράγραφο 1:
 - (α) για το ισχύον μοντέλο ISDA SIMM, χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση μετά την έναρξη ισχύος της παρούσας απόφασης·
 - (β) για κάθε προγραμματιζόμενη επικαιροποίηση του ισχύοντος μοντέλου ISDA SIMM, έως τις 14 Αυγούστου 2026.
3. Για την επικύρωση οποιασδήποτε μεταγενέστερης μεταβολής στο ISDA SIMM, η ISDA μεριμνά ώστε οι πληροφορίες που αναφέρονται στην παράγραφο 1 να παρέχονται στην ΕΑΤ σε κάθε περίπτωση το αργότερο δεκατέσσερις (14) εβδομάδες πριν από την ημερομηνία κατά την οποία η επικαιροποίηση καθίσταται εφαρμοστέα.
4. Η ISDA κοινοποιεί και παρέχει όλες τις σχετικές πληροφορίες για όλες τις επικαιροποιήσεις του ISDA SIMM. Εφόσον η επικαιροποίηση που κοινοποιείται από την ISDA δεν συνιστά μεταβολή κατά την κρίση της ΕΑΤ, συμπεριλαμβανομένων των περιπτώσεων που αναφέρονται στην παράγραφο 6, εξακολουθεί να ισχύει η επικύρωση που είχε χορηγηθεί προηγουμένως και δεν ενεργοποιείται η διαδικασία επικύρωσης.
5. Οι ακόλουθες επικαιροποιήσεις του ISDA SIMM τεκμαίρεται ότι αποτελούν μεταβολές στο ISDA SIMM:
 - (α) η επικαιροποίηση μεταβάλλει τα βασικά δομικά στοιχεία του ISDA SIMM, συμπεριλαμβανομένων του σχεδιασμού, της αποτύπωσης του κινδύνου ή των παραδοχών, ή αναθεωρεί ουσιαδώς την αντιμετώπιση των στοιχείων από τα οποία εξαρτάται το ISDA SIMM·
 - (β) η επικαιροποίηση έχει ως αποτέλεσμα την ένταξη νέων κατηγοριών περιουσιακών στοιχείων ή τύπων κινδύνων στο ISDA SIMM ή τη διαγραφή κατηγοριών περιουσιακών στοιχείων ή τύπων κινδύνων που είχαν ενταχθεί προηγουμένως σε αυτό.
6. Οι επικαιροποιήσεις που επηρεάζουν μόνο τις παραμέτρους του μοντέλου που προέρχονται από την ήδη υπάρχουσα και επικυρωμένη μεθοδολογία ISDA SIMM, συμπεριλαμβανομένων των επικαιροποιήσεων σχετικά με τους συντελεστές στάθμισης κινδύνου και τις συσχετίσεις, ή που αφορούν διευκρινίσεις, βελτιώσεις της τεκμηρίωσης και διορθώσεις ή τεχνικές αναβαθμίσεις, δεν θεωρούνται μεταβολές του ISDA SIMM.

Άρθρο 4 — Αίτηση επικύρωσης

1. Μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο, η ΕΑΤ παρέχει στους ενταγμένους αντισυμβαλλόμενους επιβεβαίωση ότι η ISDA έχει υποβάλει πλήρεις πληροφορίες και τεκμηρίωση για το ISDA SIMM, σύμφωνα με το άρθρο 3.
2. Μετά την παραλαβή της επιβεβαίωσης που αναφέρεται στην προηγούμενη παράγραφο, οι ενταγμένοι αντισυμβαλλόμενοι υποβάλλουν χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση, μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, αίτηση για την επικύρωση του μοντέλου τους, δηλώνοντας επίσης ότι αυτό συμμορφώνεται πλήρως προς το τυποποιημένο μοντέλο ISDA SIMM όπως περιγράφεται από την ISDA στις πληροφορίες και την τεκμηρίωση που υποβλήθηκαν σύμφωνα με το άρθρο 3.
3. Μεταγενέστερες αιτήσεις για μεταβολή του ISDA SIMM υποβάλλονται αυτόματα από το σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM για όλους τους ενταγμένους αντισυμβαλλόμενους που δεν έχουν δηλώσει σύμφωνα με το άρθρο 6 παράγραφος 5 είτε ότι έχουν παύσει να συμμορφώνονται προς το ISDA SIMM είτε ότι δεν υποχρεούνται πλέον να υποβάλουν αίτηση επικύρωσης και αδειοδότησης σύμφωνα με τον κανονισμό EMIR.
4. Όταν, μετά την επικύρωση του ISDA SIMM, η ΕΑΤ παραλαμβάνει αίτηση επικύρωσης του ISDA SIMM, η επικύρωση που ζητείται με την εν λόγω αίτηση χορηγείται αυτομάτως μέσω του συστήματος επικύρωσης. Η επικύρωση αυτή θα αναφέρεται στο ISDA SIMM όπως έχει επικυρωθεί.

Άρθρο 5 — Επικύρωση και άρνηση επικύρωσης του ISDA SIMM

1. Εφόσον η ISDA έχει συμμορφωθεί προς το άρθρο 3, η ΕΑΤ χορηγεί την επικύρωση του ISDA SIMM ή οποιασδήποτε μεταβολής σε αυτό, εκτός εάν η επικύρωση του ISDA SIMM ή οποιασδήποτε μεταβολής σε αυτό είναι, κατά την άποψη της ΕΑΤ, προδήλως ακατάλληλη με βάση τις συνθήκες της αγοράς ή την ανάγκη διασφάλισης της χρηματοπιστωτικής σταθερότητας.
2. Η πρώτη επικύρωση του ISDA SIMM καλύπτει όλες τις επικαιροποιήσεις και τις μεταβολές του μοντέλου μέχρι την ημερομηνία έναρξης ισχύος της απόφασης επικύρωσης και αποφασίζεται σύμφωνα με την παράγραφο 1 εντός προθεσμίας έξι μηνών από την ημερομηνία παραλαβής της πρώτης αίτησης από την ΕΑΤ σύμφωνα με το άρθρο 4.
3. Η επικύρωση οποιασδήποτε μεταβολής του ISDA SIMM αποφασίζεται σύμφωνα με την παράγραφο 1 εντός προθεσμίας τριών μηνών από την ημερομηνία παραλαβής της πρώτης αίτησης από την ΕΑΤ, σύμφωνα με το άρθρο 4. Κάθε απόφαση επικύρωσης του ISDA SIMM μετά από μεταβολή του καταργεί και αντικαθιστά τις προηγούμενες αποφάσεις επικύρωσης.
4. Η επικύρωση ή η άρνηση επικύρωσης του ISDA SIMM ή της μεταβολής του απευθύνεται σε όλους τους αντισυμβαλλόμενους που έχουν υποβάλει αίτηση σύμφωνα με το άρθρο 4.
5. Η επικύρωση του ISDA SIMM δεν υπόκειται σε χρονικό περιορισμό και ανακαλείται σύμφωνα με το άρθρο 6.

Άρθρο 6 – Ανάκληση της επικύρωσης του ISDA SIMM

1. Όταν από την παρακολούθηση που αναφέρεται στο άρθρο 7 προκύπτει ότι η διατήρηση της επικύρωσης του ISDA SIMM είναι, κατά την κρίση της ΕΑΤ, ακατάλληλη με βάση τις συνθήκες της αγοράς ή την ανάγκη διασφάλισης της χρηματοπιστωτικής σταθερότητας, η εν λόγω επικύρωση ανακαλείται εξ ολοκλήρου ή εν μέρει από την ΕΑΤ.
2. Ακόμη και όταν δεν συντρέχει περίπτωση εφαρμογής της παραγράφου 1, η ΕΑΤ ανακαλεί την επικύρωση του ISDA SIMM εάν η ISDA δεν συνεργάζεται κατά τον τρόπο που ορίζεται στην παρούσα απόφαση, μεταξύ άλλων όταν δεν παρέχει τις απαιτούμενες πληροφορίες, εκτός εάν η ανάκληση θα έθετε σε κίνδυνο την ακεραιότητα της αγοράς ή τη χρηματοπιστωτική σταθερότητα.
3. Η ΕΑΤ ανακαλεί την απόφαση επικύρωσης σύμφωνα με τις παραγράφους 1 ή 2, ανεξάρτητα από το αν οι συστάσεις που αναφέρονται στο άρθρο 7 παράγραφος 4 έχουν εφαρμοστεί από τους αποδέκτες τους.
4. Οι αποφάσεις ανάκλησης απευθύνονται σε όλους τους αντισυμβαλλομένους των οποίων τα μοντέλα έχουν επικυρωθεί σύμφωνα με την παρούσα απόφαση.
5. Η επικύρωση του ISDA SIMM ανακαλείται αυτόματα μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM για κάθε αντισυμβαλλόμενο που δηλώνει, σύμφωνα με το άρθρο 10 παράγραφος 2, είτε ότι έχει παύσει να συμμορφώνεται προς το ISDA SIMM όπως έχει επικυρωθεί από την ΕΑΤ είτε ότι δεν υποχρεούται πλέον να υποβάλει αίτηση επικύρωσης και χορήγησης άδειας σύμφωνα με τον κανονισμό EMIR.

Άρθρο 7 – Παρακολούθηση

1. Η ΕΑΤ παρακολουθεί συνεχώς την καταλληλότητα του επικυρωμένου ISDA SIMM και αναλύει τυχόν προβλήματα που αναφέρονται ή εντοπίζονται με άλλο τρόπο. Περιλαμβάνει τα κύρια πορίσματα της στην ετήσια έκθεση που αναφέρεται στο άρθρο 11 παράγραφος 12α τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR.
2. Η έκθεση παρακολούθησης που αναφέρεται στην παράγραφο 1 περιλαμβάνει τουλάχιστον τα ακόλουθα στοιχεία:

(α) τη συμμόρφωση του ISDA SIMM προς τα κριτήρια για τις γενικές απαιτήσεις, την περίοδο κινδύνου περιθωρίου (MPOR), τη βαθμονόμηση των παραμέτρων, τη διαφοροποίηση, την αντιστάθμιση κινδύνου και τις αντισταθμίσεις κινδύνου σύμφωνα με το υποκείμενο περιουσιακό στοιχείο ή τις ποιοτικές απαιτήσεις του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2016/2251 της Επιτροπής, της 4ης Οκτωβρίου 2016, που συμπληρώνει τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών όσον αφορά τα ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τις τεχνικές μείωσης του κινδύνου για συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που δεν εκκαθαρίζονται από κεντρικό αντισυμβαλλόμενο ³.

³ ΕΕ L 340 της 15.12.2016, σ. 9-46

- (β) αξιολόγηση της κάλυψης και της καταλληλότητας του συντελεστή κινδύνου, μεταξύ άλλων υπό το πρίσμα των εξελίξεων στην αγορά και των γεγονότων ακραίων καταστάσεων·
 - (γ) αξιολόγηση της βαθμονόμησης του μοντέλου·
 - (δ) αξιολόγηση της συνολικής απόδοσης του μοντέλου με βάση τα αποτελέσματα των εκ των υστέρων ελέγχων·
 - (ε) άλλα στοιχεία τα οποία τίθενται υπόψη της ΕΑΤ από την ΕΙΟΠΑ, την ESMA, τις αρμόδιες αρχές ή την ISDA.
3. Η παρακολούθηση της ΕΑΤ που αναφέρεται στο παρόν άρθρο δεν εμποδίζει την ΕΑΤ να επαναξιολογεί σε ad hoc βάση, μεταξύ άλλων σε καταστάσεις έκτακτης ανάγκης ή δυσμενείς εξελίξεις της αγοράς, κατά πόσον η επικύρωση του ISDA SIMM εξακολουθεί να είναι κατάλληλη.
 4. Στην ετήσια έκθεση που αναφέρεται στο άρθρο 11 παράγραφος 12α τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR, η ΕΑΤ μπορεί να διατυπώσει συστάσεις για τυχόν ζητήματα που πρέπει να αντιμετωπιστούν από την ISDA ή από οποιονδήποτε χρήστη του συστήματος επικύρωσης. Οι συστάσεις αυτές μπορεί να αφορούν κινδύνους, παράγοντες που δεν αντικατοπτρίζονται επαρκώς στο επικυρωμένο ISDA SIMM, το πεδίο εφαρμογής, την κάλυψη των μέσων και των κατηγοριών περιουσιακών στοιχείων, τη βαθμονόμηση ή οποιαδήποτε άλλη μεθοδολογία βάσει ου ISDA SIMM, όπως επικυρώθηκε από την ΕΑΤ ή βάσει οποιασδήποτε προβλεπόμενης μεταβολής του.

Άρθρο 8 – Δικαίωμα ακρόασης

1. Εάν η ΕΑΤ δεν προτίθεται να χορηγήσει επικύρωση στο ISDA SIMM ή προτίθεται να ανακαλέσει εν μέρει ή εν όλω την επικύρωση λόγω ακαταλληλότητας του ISDA SIMM, οι αντισυμβαλλόμενοι που έχουν υποβάλει αίτηση επικύρωσης σύμφωνα με το άρθρο 4 ή των οποίων τα μοντέλα έχουν επικυρωθεί βάσει της παρούσας απόφασης ενημερώνονται για την πρόθεση της ΕΑΤ και έχουν στη διάθεσή τους προθεσμία είκοσι [20] εργάσιμων ημερών εντός της οποίας μπορούν να διατυπώσουν τις απόψεις τους.
2. Η κοινοποίηση και η διατύπωση απόψεων που αναφέρονται στην προηγούμενη παράγραφο πραγματοποιούνται μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ.

Άρθρο 9 - Διαφάνεια

1. Κάθε απόφαση για τη χορήγηση ή την άρνηση επικύρωσης και κάθε απόφαση για μερική ή ολική ανάκληση της επικύρωσης κοινοποιείται σε όλους τους χρήστες μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM.
2. Κάθε απόφαση άρνησης και κάθε απόφαση μερικής ή ολικής ανάκλησης της επικύρωσης πρέπει να αναφέρει τους λόγους στους οποίους βασίζεται και να ενημερώνει τους αντισυμβαλλομένους για τα ένδικα μέσα που έχουν στη διάθεσή τους σύμφωνα με τον κανονισμό της ΕΑΤ.

- Κάθε απόφαση χορήγησης ή άρνησης επικύρωσης και κάθε απόφαση μερικής ή ολικής ανάκλησης της επικύρωσης, καθώς και κάθε άποψη που υποβάλλεται στο πλαίσιο της άσκησης του δικαιώματος ακρόασης, δημοσιεύεται στον δικτυακό τόπο της ΕΑΤ χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση, εκτός εάν, κατά την άποψη της ΕΑΤ, η εν λόγω δημοσίευση έρχεται σε σύγκρουση με το έννομο συμφέρον των συγκεκριμένων χρηματοπιστωτικών ιδρυμάτων ή με την προστασία του επιχειρηματικού απορρήτου τους ή ενδέχεται να θέσει σε σοβαρό κίνδυνο την εύρυθμη λειτουργία και την ακεραιότητα των χρηματοπιστωτικών αγορών ή τη σταθερότητα του συνόλου ή μέρους του χρηματοπιστωτικού συστήματος της Ένωσης.

Άρθρο 10 – Απαιτήσεις παροχής πληροφοριών και συνεργασίας

- Οι αρμόδιες αρχές:

(α) διασφαλίζουν ότι το σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM περιέχει ακριβείς και επικαιροποιημένες πληροφορίες σχετικά με τους αντισυμβαλλόμενους που έχουν υποβάλει αίτηση για χορήγηση άδειας σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 3 τρίτο εδάφιο του κανονισμού EMIR για κάθε μοντέλο αρχικού περιθωρίου ασφαλείας που βασίζεται στο ISDA SIMM· και

(β) παρέχουν στην ΕΑΤ, μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, τις πληροφορίες που συλλέγουν κατά τη διάρκεια της αρχικής και της εν εξελίξει διαδικασίας χορήγησης άδειας του ISDA SIMM σε επίπεδο οντότητας ή οποιασδήποτε μεταβολής του.

- Οι αντισυμβαλλόμενοι ενημερώνουν την ΕΑΤ μέσω του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση, όταν παύουν να συμμορφώνονται προς το ISDA SIMM όπως ισχύει μετά την πλέον πρόσφατη επικαιροποίησή του ή δεν υποχρεούνται πλέον να υποβάλουν αίτηση για επικύρωση και χορήγηση άδειας σύμφωνα με τον κανονισμό EMIR.
- Οι χρήστες παρέχουν στην ΕΑΤ, μέσω του συστήματος επικύρωσης ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, τις πληροφορίες που είναι απαραίτητες για την αποτελεσματική διενέργεια της επικύρωσης και της αξιολόγησης της διαρκούς καταλληλότητας του ISDA SIMM, συμπεριλαμβανομένων, ενδεικτικά, των πληροφοριών που ορίζονται στο παράρτημα.
- Οι χρήστες παρέχουν στην ΕΑΤ, μέσω του συστήματος επικύρωσης ή με οποιοδήποτε άλλο μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, κάθε πρόσθετη πληροφορία και τα στοιχεία που η ΕΑΤ θεωρεί απαραίτητα για την άσκηση της λειτουργίας επικύρωσης.
- Μεταξύ των πληροφοριών που αναφέρονται στην προηγούμενη παράγραφο περιλαμβάνονται, ενδεικτικά, πληροφορίες και στοιχεία σχετικά με τη χρήση, την απόδοση, τη βαθμονόμηση ή την εφαρμογή του ISDA SIMM, πληροφορίες και στοιχεία σχετικά με το ποσό των περιθωρίων ασφαλείας που υπολογίζονται μέσω τυποποιημένων μοντέλων πλέγματος κατανομής ή αρχικών περιθωρίων ασφαλείας, ποιοτικές πληροφορίες σχετικά με ρητές επιλογές μη χρήσης μοντέλων αρχικών περιθωρίων ασφαλείας, στατιστικά στοιχεία σχετικά με διαδικασίες αντιστοίχισης και διαφορές, λεπτομέρειες σχετικά με τις σημαντικότερες διαφορές, καθώς και στατιστικά στοιχεία και δεδομένα σχετικά με προσαυξήσεις που εφαρμόζονται επιπλέον του αρχικού περιθωρίου ασφαλείας.

6. Εκτός από την παροχή των πληροφοριών και των στοιχείων που αναφέρονται στις ανωτέρω παραγράφους, οι χρήστες συνεργάζονται, χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση, με την ΕΑΤ, ώστε αυτή να είναι σε θέση να εκτελεί την οικεία λειτουργία επικύρωσης και παρέχουν στην ΕΑΤ, μέσω του συστήματος επικύρωσης ή με οποιοδήποτε μέσο κρίνει κατάλληλο η ΕΑΤ, κάθε πληροφορία που αυτή ζητεί.

Άρθρο 11 – Λήψη αποφάσεων

1. Η πρώτη απόφαση για τη χορήγηση επικύρωσης στο ISDA SIMM, η απόφαση για την άρνηση επικύρωσης και η απόφαση για την πλήρη ή μερική ανάκληση της επικύρωσης λαμβάνονται, σύμφωνα με τα άρθρα 5 και 6, από το συμβούλιο εποπτών.
2. Κάθε μεταγενέστερη απόφαση για την επικύρωση μιας μεταβολής στο ISDA SIMM, σύμφωνα με το άρθρο 5 παράγραφος 1, λαμβάνεται από τη Μόνιμη Επιτροπή σχετικά με τη Ρύθμιση και την Πολιτική (SCRePol). Το συμβούλιο εποπτών ενημερώνεται δεόντως για τις αποφάσεις αυτές. Η SCRePol επιδιώκει την επίτευξη συναίνεσης κατά την έγκριση αποφάσεων για την επικύρωση μεταβολών στο ISDA SIMM. Ελλείψει συναίνεσης, η απόφαση εκδίδεται με απλή πλειοψηφία των μελών της SCRePol που διορίζονται από μέλος του συμβουλίου εποπτών με δικαίωμα ψήφου. Οι αποχές ή η μη έκφραση γνώμης υπολογίζονται υπέρ της απόφασης. Εάν η SCRePol κρίνει ότι η επικύρωση μιας μεταβολής του μοντέλου ISDA SIMM πρέπει να απορριφθεί, αποστέλλει την πρότασή της στο συμβούλιο εποπτών για τη λήψη της τελικής απόφασης.
3. Ο εκτελεστικός διευθυντής εξουσιοδοτείται να λαμβάνει τις ακόλουθες αποφάσεις ενημερώνοντας δεόντως το συμβούλιο εποπτών:

(α) ζητεί πρόσθετες πληροφορίες ή ειδική συνεργασία από οποιονδήποτε χρήστη σχετικά με συγκεκριμένο θέμα που αφορά την εφαρμογή της παρούσας απόφασης· και

(β) καθορίζει το πεδίο εφαρμογής, το περιεχόμενο, τη μορφή, τη συχνότητα, τις ημερομηνίες αναφοράς, τους κανόνες ΤΠ, τους κανόνες επικύρωσης και τις οδηγίες για τις πληροφορίες και τα δεδομένα που περιλαμβάνονται στο σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM, τον σκοπό της επεξεργασίας των δεδομένων προσωπικού χαρακτήρα και το δικαίωμα πρόσβασης στο σύστημα επικύρωσης ISDA SIMM καθώς και κάθε άλλο λειτουργικό κανόνα ή τεχνική προδιαγραφή που είναι απαραίτητα («τεχνικές προδιαγραφές του συστήματος επικύρωσης ISDA SIMM») για την εφαρμογή της παρούσας απόφασης.

Άρθρο 12 – Τελικές διατάξεις

Η παρούσα απόφαση τίθεται σε ισχύ την 1η Μαρτίου 2026.

Παρίσι,

José Manuel Campa
Πρόεδρος
Για το συμβούλιο εποπτών

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ 1

Οι πληροφορίες που αναφέρονται παρακάτω πρέπει να παρέχονται για κάθε νομική οντότητα (δηλ. αντισυμβαλλόμενο κατά την έννοια του EMIR) που είναι εγκατεστημένη στον ΕΟΧ και υπόκειται στην απαίτηση ανταλλαγής αρχικού περιθωρίου ασφαλείας σύμφωνα με τον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2016/2251 της Επιτροπής⁴ («Κοινά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα των ΕΕΑ για μη εκκαθαρισμένα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα») και είναι αδειοδοτημένος χρήστης του ISDA SIMM – είτε μεμονωμένα είτε ως μέλος ομίλου (δηλ. είτε εντός ΕΟΧ είτε εκτός ΕΟΧ)

Πληροφορίες ταυτοποίησης

- Επωνυμία του νομικού προσώπου·
- Κωδικός LEI·
- Φύση της οντότητας (π.χ. μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, πιστωτικό ίδρυμα, επιχείρηση επενδύσεων, οργανισμός συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ), οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων (ΟΕΕ), ασφαλιστική εταιρεία)·
- Χώρα στην οποία είναι εγκατεστημένη η οντότητα·
- Αρμόδια αρχή που είναι υπεύθυνη για τη χορήγηση άδειας στο μοντέλο αρχικού περιθωρίου ασφαλείας της οντότητας·

Πληροφορίες για τον όγκο του αρχικού περιθωρίου ασφαλείας

- Αξιολόγηση του κλιμακίου (δηλαδή των κλιμακίων 1 έως 6) στο οποίο ανήκει επί του παρόντος η οντότητα σύμφωνα με το άρθρο 36 των κοινών ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων των ΕΕΑ σχετικά με μη εκκαθαρισμένα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα (π.χ. Μέσο συνολικό ονομαστικό ποσό (AANA) > 3 000 δισεκατ. EUR, 8 δισεκατ. EUR < AANA <= 50 δισεκατ. EUR)·
- Ένδειξη αν η οντότητα έχει μηνιαίο μέσο ανεξόφλητο ονομαστικό ποσό μη κεντρικά εκκαθαριζόμενων συμβάσεων εξωχρηματιστηριακών παραγώγων ύψους τουλάχιστον 750 δισεκατομμυρίων EUR σε επίπεδο ομίλου, όπως αναφέρεται στο άρθρο 11 παράγραφος 15 πρώτο εδάφιο στοιχείο αα) του κανονισμού EMIR (Ναι/Όχι)·

Στοιχεία επικοινωνίας και ΤΠ

- Λειτουργική διεύθυνση ηλεκτρονικού ταχυδρομείου της ομάδας που είναι υπεύθυνη για τη χορήγηση άδειας μοντέλου αρχικού περιθωρίου ασφαλείας στην οντότητα·

⁴ ΕΕ L 340 της 15.12.2016, σ. 9-46

- Τομείς ηλεκτρονικού ταχυδρομείου που χρησιμοποιούνται από την οντότητα.
- Στοιχεία επικοινωνίας του υπευθύνου επικοινωνίας 1.

Ο υπεύθυνος επικοινωνίας 1 είναι αρμόδιος για τη διαχείριση της πρόσβασης του αντισυμβαλλομένου στο σύστημα επικύρωσης της ΕΑΤ για την επικύρωση του ISDA SIMM. Ο εν λόγω υπεύθυνος επικοινωνίας μπορεί επίσης να έχει τον ρόλο του υποβάλλοντος τα στοιχεία του μοντέλου επικύρωσης αρχικού περιθωρίου ασφαλείας (IMMV):

- Ονοματεπώνυμο
 - Ρόλος στο ίδρυμα
 - Διεύθυνση e-mail και αριθμός τηλεφώνου.
- Στοιχεία επικοινωνίας των υπευθύνων επικοινωνίας 2 και 3.

Οι υπεύθυνοι επικοινωνίας 2 και 3 θα έχουν το ρόλο των υποβαλλόντων τα δεδομένα IMMV:

- Ονοματεπώνυμο
- Ρόλος στο ίδρυμα
- Διεύθυνση e-mail και αριθμός τηλεφώνου.

Πληροφορίες σχετικά με τον όμιλο στον οποίο ανήκει η οντότητα

Σε περίπτωση που η οντότητα ανήκει σε όμιλο εγκατεστημένο εντός του ΕΟΧ, ήτοι είναι άμεση ή έμμεση θυγατρική άλλης οντότητας εγκατεστημένης στον ΕΟΧ, αναφέρονται τα ακόλουθα για την ιεραρχικώς ανώτερη οντότητα του ομίλου η οποία βρίσκεται εγκατεστημένη στον ΕΟΧ («τελική μητρική επιχείρηση εντός του ΕΟΧ»):

- Επωνυμία της τελικής μητρικής επιχείρησης εντός του ΕΟΧ.
- Κωδικός LEI της τελικής μητρικής επιχείρησης εντός του ΕΟΧ.
- Χώρα στην οποία είναι εγκατεστημένη η τελική μητρική επιχείρηση εντός του ΕΟΧ.
- Φύση της τελικής μητρικής επιχείρησης εντός του ΕΟΧ [π.χ. μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, πιστωτικό ίδρυμα, επιχείρηση επενδύσεων, οργανισμός συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ), οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων (ΟΕΕ), ασφαλιστική εταιρεία].

Επιπλέον, σε περίπτωση που οι νομικές οντότητες ανήκουν σε όμιλο εγκατεστημένο εκτός του ΕΟΧ (δηλαδή η τελική μητρική οντότητα του ομίλου βρίσκεται εγκατεστημένη εκτός του ΕΟΧ),

αναφέρονται τα ακόλουθα στοιχεία για την ιεραρχικώς ανώτερη οντότητα του ομίλου η οποία βρίσκεται εγκατεστημένη εκτός του ΕΟΧ («τελική μητρική επιχείρηση εκτός του ΕΟΧ»):

- Επωνυμία της τελικής μητρικής επιχείρησης εκτός ΕΟΧ·
- Κωδικός LEI της τελικής μητρικής επιχείρησης εκτός ΕΟΧ·
- Χώρα όπου είναι εγκατεστημένη η τελική μητρική εταιρεία εκτός ΕΟΧ·
- Φύση της τελικής μητρικής επιχείρησης εκτός ΕΟΧ [π.χ. μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, πιστωτικό ίδρυμα, επιχείρηση επενδύσεων, οργανισμός συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ), οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων (ΟΕΕ), ασφαλιστική εταιρεία].

Οι αρμόδιες αρχές παρέχουν τις πληροφορίες με τη μορφή και σύμφωνα με τις οδηγίες που καθορίζονται από την ΕΑΤ.

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ 2

Οι πληροφορίες που αναφέρονται παρακάτω πρέπει να παρέχονται για κάθε νομική οντότητα (δηλ. αντισυμβαλλόμενο κατά την έννοια του EMIR) που είναι εγκατεστημένη στον ΕΟΧ και υπόκειται στην απαίτηση ανταλλαγής αρχικού περιθωρίου ασφαλείας σύμφωνα με τον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2016/2251 της Επιτροπής⁵ («Κοινά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα των ΕΕΑ για μη εκκαθαρισμένα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα») και έχει καταστεί αδειοδοτημένος χρήστης του ISDA SIMM – είτε μεμονωμένα είτε ως μέλος ομίλου (δηλ. είτε εντός ΕΟΧ είτε εκτός ΕΟΧ)

Πληροφορίες ταυτοποίησης

- Επωνυμία της νομικής οντότητας σε ατομικό επίπεδο·
- Χώρα στην οποία είναι εγκατεστημένη η οντότητα·
- Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI).

⁵ ΕΕ L 340 της 15.12.2016, σ. 9–46